

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項
(2023年9月期自己資本比率)

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (連結)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2023年9月期)	前四半期末 (2023年6月期)	当四半期末 (2023年9月期)	前四半期末 (2023年6月期)
1	信用リスク	3,159,534	3,240,761	265,555	272,424
2	うち、標準的手法適用分	437,171	440,579	34,973	35,246
3	うち、内部格付手法適用分	2,665,188	2,742,476	226,008	232,561
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	3,692	3,710	295	296
	その他	53,481	53,994	4,278	4,319
4	カウンターパーティ信用リスク	53,227	58,870	4,407	4,878
5	うち、SA-CCR適用分	8,576	9,674	725	818
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,888	20,564	1,511	1,645
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,347	1,234	107	98
	その他	24,415	27,397	2,063	2,315
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	327,783	300,843	27,796	25,511
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	155,154	149,778	12,412	11,982
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	106,428	4,783	8,514	382
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	19,698	38,551	1,670	3,269
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	22,859	39,520	1,938	3,351
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	760,713	948,146	60,857	75,851
11	未決済取引	—	—	—	—
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	37,076	36,902	2,966	2,952
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	37,076	36,902	2,966	2,952
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	208,524	183,496	16,681	14,679
20	うち、基礎的手法適用分	208,524	183,496	16,681	14,679
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	560	560	47	47
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計	4,851,560	5,002,215	402,847	415,331

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (単体)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2023年9月期)	前四半期末 (2023年6月期)	当四半期末 (2023年9月期)	前四半期末 (2023年6月期)
1	信用リスク	2,654,998	2,727,291	224,945	231,091
2	うち、標準的手法適用分	5,442	6,659	435	532
3	うち、内部格付手法適用分	2,613,763	2,689,102	221,647	228,035
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	—	—	—	—
	その他	35,792	31,530	2,863	2,522
4	カウンターパーティ信用リスク	49,924	54,870	4,143	4,558
5	うち、SA-CCR適用分	8,237	9,255	698	784
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,414	18,531	1,393	1,482
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,347	1,234	107	98
	その他	22,925	25,849	1,944	2,192
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	323,595	298,150	27,440	25,283
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	222,807	216,424	17,824	17,313
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	106,428	4,783	8,514	382
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	19,633	38,487	1,664	3,263
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	22,855	39,511	1,938	3,350
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	758,552	946,220	60,684	75,697
11	未決済取引	—	—	—	—
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	37,076	36,902	2,966	2,952
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	37,076	36,902	2,966	2,952
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	156,274	155,209	12,501	12,416
20	うち、基礎的手法適用分	156,274	155,209	12,501	12,416
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	—	—	—	—
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計	4,352,146	4,517,851	362,624	376,309

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。